Manual de Usuario RiskAssistant

Versión 4.4.0.1

Tabla de Contenido

1. PANTALLAS DEL MÓDULO RISK ASSISTANT 3
1.1. Ingreso al sistema 3
2. PANTALLAS MENÚ DE CONFIGURACIÓN 5
2.1. Pantalla: Respaldo y Restauración 5
2.2. Pantalla: Listado de Reportes 7
2.3. Configuración de Base de Datos. 9
2.4. Configuración de Conexión a Servicios 11
2.5. Configuración de Reportes XML 12
2.6. Mantenimiento Panel de Exposición. 14
2.7. Configuración de Límites. 16
3. MENÚ RIESGO DE CRÉDITO 18
3.1. Reportes de Crédito 18
3.2. Matrices de migración. 20
3.3. Pérdida Esperada. 21
3.4. Back Testing. 22
3.5. Reporte de Categorías y Criterios de Riesgo. 24
3.6. Créditos por Sectores Económicos. 25
4. MENÚ RIESGO DE MERCADO. 27
4.1. Reportes de Mercado 27
4.2. Modelación Paramétrica 29
4.3. Simulación Montecarlo. 31
4.4. Cálculo de Indicadores. 33
5. MENÚ RIESGO DE LIQUIDEZ. 35
5.1. Reportes de Liquidez 35
6. MENÚ RIESGO OPERACIONAL. 37
6.1. Reportes de Operacional 37
6.2. Modelación Paramétrica 39
7. OTROS REPORTES 42
7.1. Reporte de Financiamientos. 42
7.2. Reporte de Captaciones. 44
7.3. Reporte de Inversiones 46
7.4. Matrices y Archivos de Cálculo. 48
7.5. Abrir Cubos (Opción disponible según licenciamiento) 49

8. MENÚ: PANEL DE EXPOSICIÓN 50
8.1. Panel de Exposición a una fecha de corte. 50
8.2. Panel de Exposición comparativo. 51
8.3. Control Riesgo de Tasa de Interés. 53
8.4. Control Riesgo de Tipo de Cambio. 55
8.5. Control Riesgo de Liquidez. 57
9. MENÚ: AYUDA 59
9.1. Acerca de 59
9.2. Manual de Usuario 59
9.3. Solicitar Soporte Remoto. 59
9.4. Support Center. 60
9.5. Control de Versiones. 60

1. Pantallas del Módulo Risk Assistant

1.1. Ingreso al sistema

Para ingresar el sistema haga un doble *clic* sobre el acceso directo de la aplicación. Inmediatamente aparecerá la pantalla en la que deberá indicar el nombre de usuario y contraseña.

Pantalla de ingreso RiskAssistant

Las funcionalidades de la aplicación varían en razón de los privilegios asignados al usuario. El departamento de seguridad tiene la responsabilidad de crear los usuarios, los perfiles y los privilegios asignados a los perfiles, reseteo de claves, desbloqueo usuarios entre otros elementos que son controlados desde el Security Support, para mayor información consulte el Manual de Usuario del Security Support.

Es importante recordar que luego de tres intentos fallidos, la aplicación se bloqueará, por lo que debe solicitar al departamento de seguridad el reseteo de su cuenta. En caso de que el usuario no recuerde la contraseña puede solicitar la asignación de una

contraseña de primer acceso. Las contraseñas de primer acceso permiten la personalización de la contraseña exclusivamente. No será posible acceder a la aplicación utilizando esta contraseña.

Una vez completado el proceso de validación el usuario tendrá acceso a la aplicación. A continuación, se detallarán los menús y las pantallas del sistema. En cada sección se incluye una descripción del funcionamiento de la pantalla, una descripción de cada botón o campo que compone la pantalla, así como los pasos para utilizar la pantalla.

Este manual se complementa con el Manual de Usuario del RiskDwtools y con el Manual de Modelos. En el primero, se detalla el procedimiento para validar, cargar y transformar los datos en reportes e indicadores. En el segundo manual, se definen los mecanismos de cálculo que la aplicación utilizada para llegar a los reportes e indicadores.

2. Pantallas Menú de Configuración

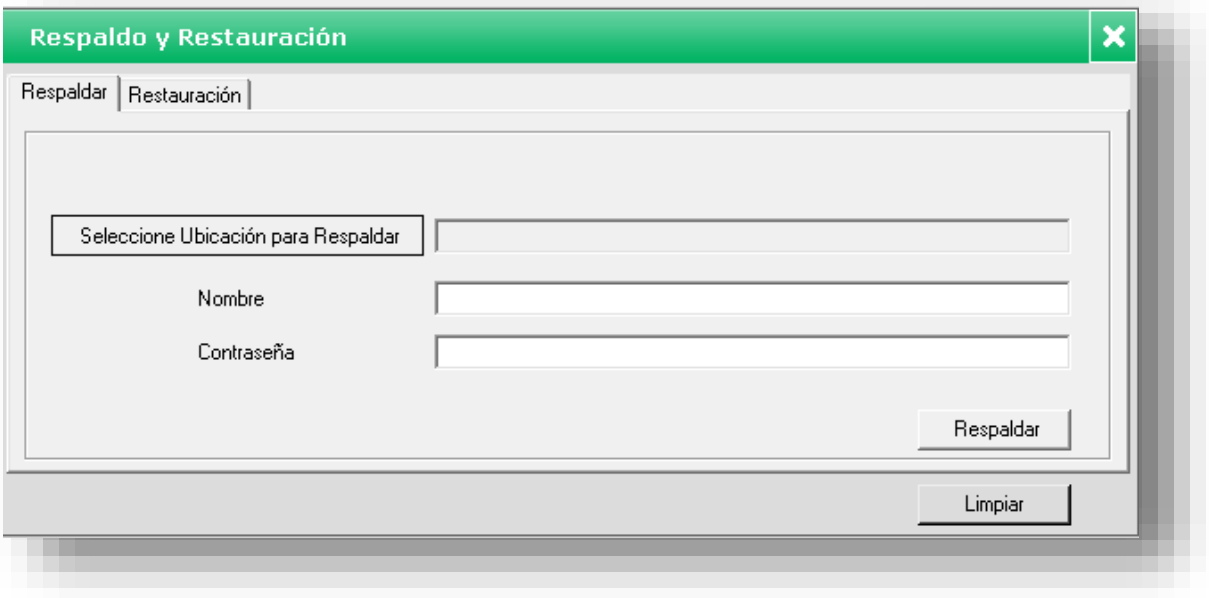
2.1. Pantalla: Respaldo y Restauración

Dentro de la Carpeta del RiskAssistant se almacenan las plantillas con los formatos de salida. Estas plantillas son archivos de Excel 2003, que están preparadas para recibir la información de los reportes. Las plantillas fueron preparadas con tablas, tablas dinámicas, encabezados, y gráficos; de modo que la información se coloque dentro de la plantilla y resulte más sencillo la interpretación y ampliación en caso de ser necesario.

El cliente podrá personalizar las plantillas incluyendo tablas adicionales, gráficos y el logo de la compañía, entre otros. La personalización de las plantillas no deberá afectar las hojas creadas originalmente o las referencias del archivo.

En caso que el cliente realice una personalización de sus archivos podrá apoyarse para respaldar o compartir su personalización mediante la pantalla de "Respaldo y Restauración".

Pantalla de Respaldo y Restauración.

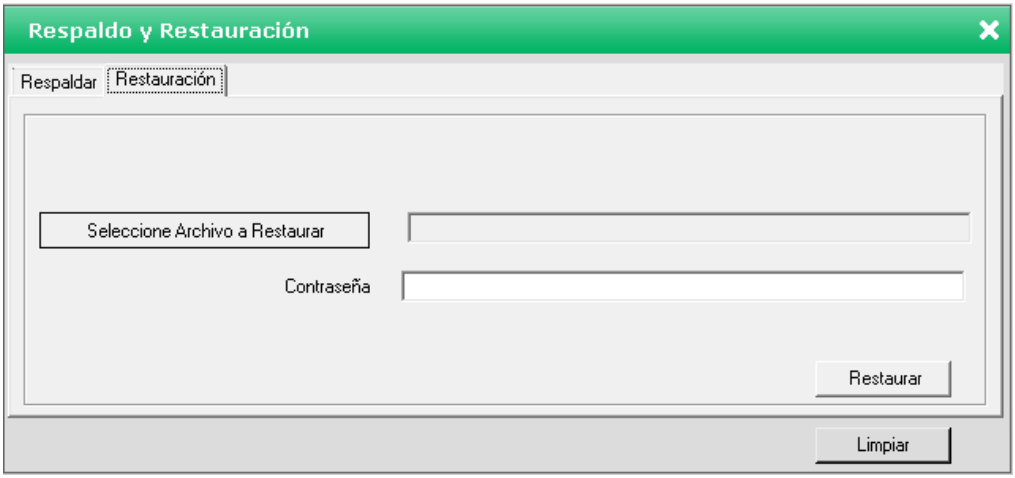


Pasos para la realización de un respaldo de la Carpeta XML.

1. Abra la pantalla Respaldo y Restauración del XML
2. Seleccione la cejilla bajo el nombre de “Respaldar”, tal y como se muestra en la siguiente imagen.
3. Haga *clic* en el botón “Seleccionar Ubicación para Respaldar” para determinar el sitio dentro de su computador en donde almacenará el respaldo.
4. En el Campo “Nombre” digite el nombre con el que desea guardar el respaldo.
5. Digite una contraseña si desea proteger la información.
6. Haga *clic* en el botón “Respaldar”.
7. Si desea iniciar nuevamente el proceso puede hacer un *clic* en el botón “Limpiar” eliminar la información colocada en los campos.
8. El sistema le confirmará la realización exitosa del respaldo al concluir.

Pasos para restaurar un respaldo.

1. Abra la pantalla “Respaldo y Restauración”.
2. Seleccione la cejilla bajo el nombre de “Restauración”.
3. Haga clic en el botón “Archivo a Restaurar” para determinar el sitio dentro de su computador donde está ubicado el respaldo.
4. Digite la contraseña en caso que el archivo de respaldo estuviera protegido.
5. Haga *clic* en el botón “Restaurar”



6. Si desea iniciar nuevamente el proceso puede hacer un *clic* en el botón “Limpiar” eliminar la información colocada en los campos.
7. El sistema le confirmará la realización exitosa de la restauraciónal concluir.

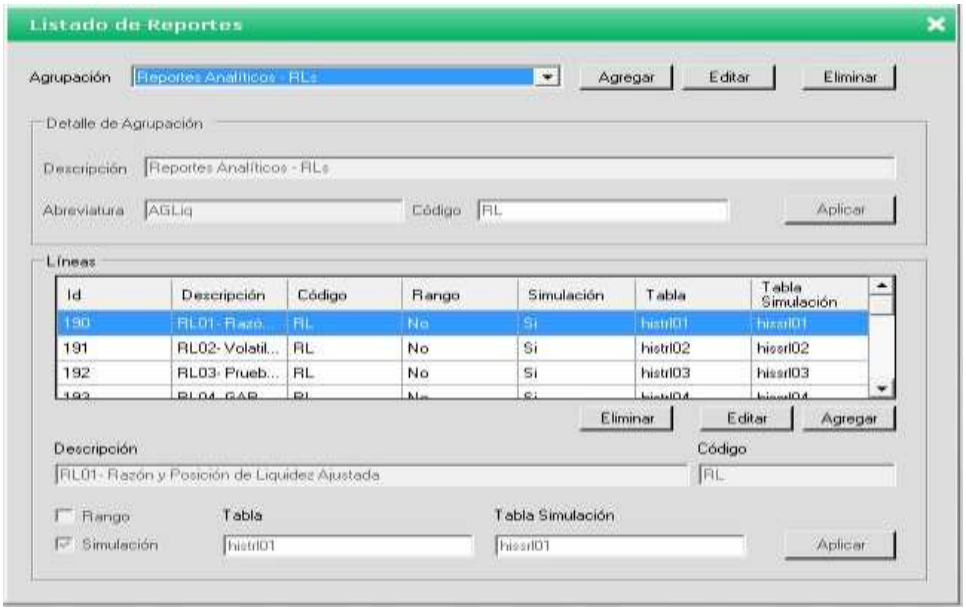
2.2. Pantalla: Listado de Reportes

Esta pantalla permite visualizar, editar, o eliminar los reportes que produce el Risk Assistant. Como requiere de conocimientos técnicos, está desarrollada exclusivamente para el uso de usuarios de nivel administrador o personal de soporte de ASM.

Una vez abierta la pantalla, el usuario podrá visualizar la codificación de los reportes organizados por su agrupación, así como el nombre con el que fueron creados.

A continuación se muestra una imagen de la pantalla, como una explicación de lo campos que la componen.

Pantalla de Configuración de Reportes



Campos de la pantalla:

1. Agrupación: Detalla la agrupación a la que corresponde el reporte, por ejemplo riesgo de liquidez o riesgo de mercado.

2. Descripción de la Agrupación: Este campo se utiliza para ampliar detalles sobre la agrupación creada.

3. Código del Reporte: Corresponde al código asignado al reporte, esta codificación es única por agrupación y deberá ser de dos (2) caracteres.

4. Nombre del Reporte: El nombre del reporte debe, en todos los casos, estar conformado por el código del reporte más dos caracteres adicionales únicos, de tal forma que se cree un código único para el reporte. Seguido del código deberá incluirse un guion y un espacio; luego se deberá colocar el nombre descriptivo del reporte. Por ejemplo.: "RL01- Razón de Liquidez Ajustada"

5. Botón Agregar: Permite agregar nuevos reportes.

7. Botón Eliminar Fila Seleccionada: Permite eliminar reportes mal creados o reportes que no será utilizados.

Pasos para crear un nuevo Reporte

1. Abra la pantalla "Listado de Reporte" incluida en el menú de Mantenimiento.
2. Seleccione la agrupación para la que desea crear un nuevo reporte.
3. Complete los campos de la pantalla.
4. Haga *clic* en "agregar".

Pasos para editar un Reporte existente

1. Abra la pantalla "Listado de Reportes" incluida en el menú de Mantenimiento.
2. Seleccione la agrupación del reporte que desea editar.
3. Busque dentro del *Grid* el reporte que desea editar.
4. Modifique directamente en el *Grid* el o los campos.

Pasos para eliminar un Reporte existente

5. Abra la pantalla "Listado de Reportes" incluida en el menú de Mantenimiento.
6. Seleccione la agrupación del reporte que desea borrar.
7. Busque dentro del *Grid* el reporte que desea borrar y selecciónelo haciendo *clic* sobre la línea del reporte.
8. Haga *clic* en el botón "Eliminar fila Seleccionada"

2.3. Configuración de Base de Datos.

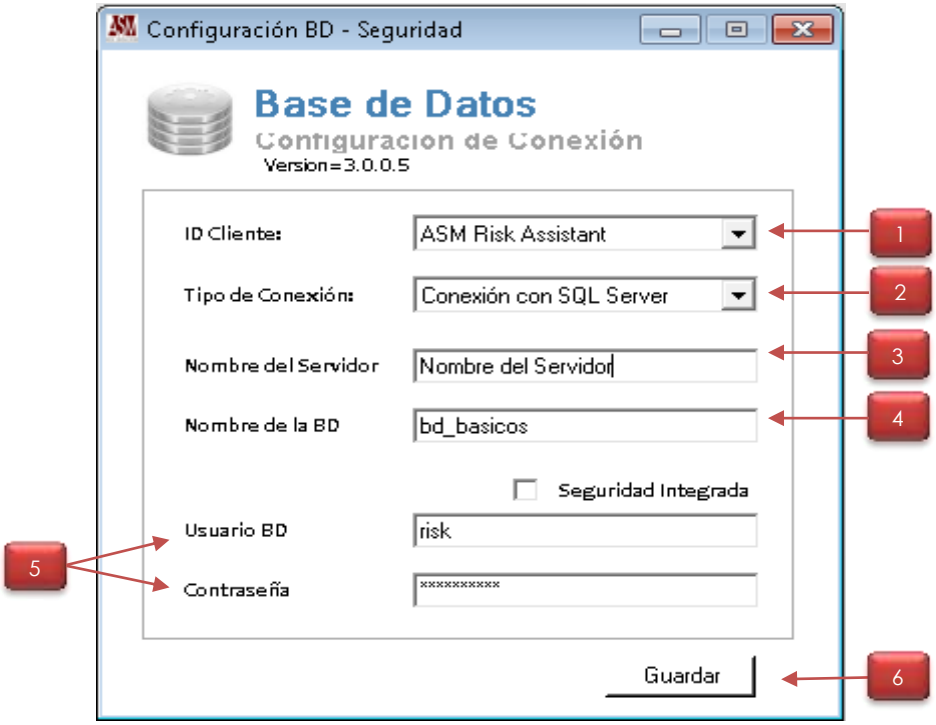
Esta pantalla permite establecer los datos de conexión entre el equipo del usuario y la base de datos. La configuración deberá realizarse durante el proceso de instalación o cuando se presuma que la aplicación no está conectando con el servidor de base de datos.

A continuación se muestra la pantalla de configuración de base de datos y la descripción de los campos que la componen.

1. Id Cliente: Corresponde al nombre del cliente del Aplicativo.

2. Tipo de Conexión: Corresponde al tipo servidor en el que se encuentren alojadas las bases de datos. Es posible utiliza servidor SQL u Oracle, según las condiciones de contratación y licenciamiento.

3. Nombre de la Base de Datos: Corresponde al nombre de la base de datos de configuración, por defecto, el nombre de la base de datos es *bd_basicos.* Solo deberá modificarse este nombre en los casos en que el personal de soporte de ASM así lo recomiende.



4. Usuario de BD: Corresponde al nombre de usuario de base de datos.

5. Contraseña: Corresponde a la contraseña asociada al usuario de base de datos.

6. Botón Guarda: Permite almacenar los datos de conexión digitados.

Pasos para el uso de la pantalla:

1. Abra la pantalla de "Configuración de BD"
2. Seleccione el ID cliente. Normalmente solo existe una opción disponible para seleccionar.
3. Seleccione el tipo de servidor que utiliza sea, SQL u Oracle.
4. Digite el nombre de la base de datos. Por defecto el valor a digitar es *bd_basicos*
5. Digite el nombre de usuario de base de datos.
6. Digite la contraseña asociada al usuario digitado en el punto 5.
7. Haga *clic* en "guardar".

2.4. Configuración de Conexión a Servicios

Algunos reportes e indicadores son generados utilizando un servicio Web o WebService. En estos casos, es necesaria la configuración de estos servicios en la pantalla que se muestra a continuación.

Pasos para agregar un nuevo servicio.

1. Abra la pantalla Configuración de "Conexión a Servicios" incluida en el menú de Mantenimiento.
2. Digite el ID de Dirección (Referencia 1). Este ID es único. En caso de no conocer el número de ID del servicio solicite soporte al personal de ASM.
3. Digite la dirección del servicio (Referencia 2). La dirección del servicio varía de acuerdo al servicio que desea activar. Si no conoce el nombre del servicio, solicite ayuda con el personal de soporte de ASM.
4. Haga *clic* en el botón "guardar" ((Referencia 3).
5. El sistema confirmará que los cambios fueron aplicados satisfactoriamente.

Pasos para editar servicio.

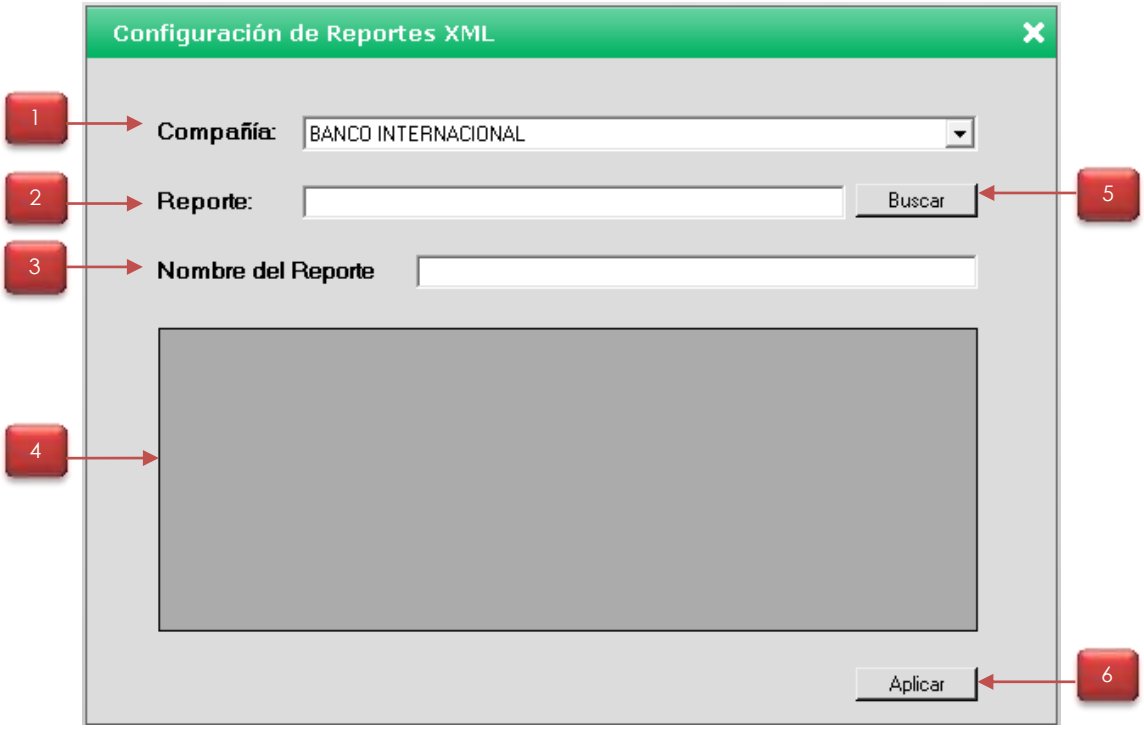
1. Abra la pantalla Configuración de “Conexión a Servicios” incluida en el menú de Mantenimiento.
2. Seleccione del *Grid*(Referencia 4) el servicio que desea editar.
3. Modifique los valores ya sea el ID del servicio o la dirección.
4. Haga *clic* en el botón “actualizar” (Referencia 5).
5. El sistema confirmará que los cambios fueron aplicados satisfactoriamente.

Pasos para borrar un servicio.

1. Abra la pantalla Configuración de “Conexión de Servicios” incluida en el menú de Mantenimiento.
2. Seleccione del *Grid (Referencia 4)* el servicio que desea borrar.
3. Haga *clic* en el botón “eliminar” (Referencia 6).
4. Confirme que desea eliminar el servicio.
5. El sistema confirmará que los cambios fueron aplicados satisfactoriamente.

2.5. Configuración de Reportes XML

En esta pantalla el usuario podrá definir el formato de exportación de los reportes a XML.



Opciones de la pantalla:

1. Compañía: Corresponde a la empresa para la que se está configurado la exportación del reporte a formato XML.

2. Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que desea configurar. Este campo se carga con base en la información seleccionada en la búsqueda.

3. Nombre del Reporte: Corresponde al nombre principal del reporte según formado del XML.

4. Grid: Muestra los campos del reporte y los nombres de exportación al archivo XML.

5. Buscar: Permite buscar el reporte que se desea configurar.

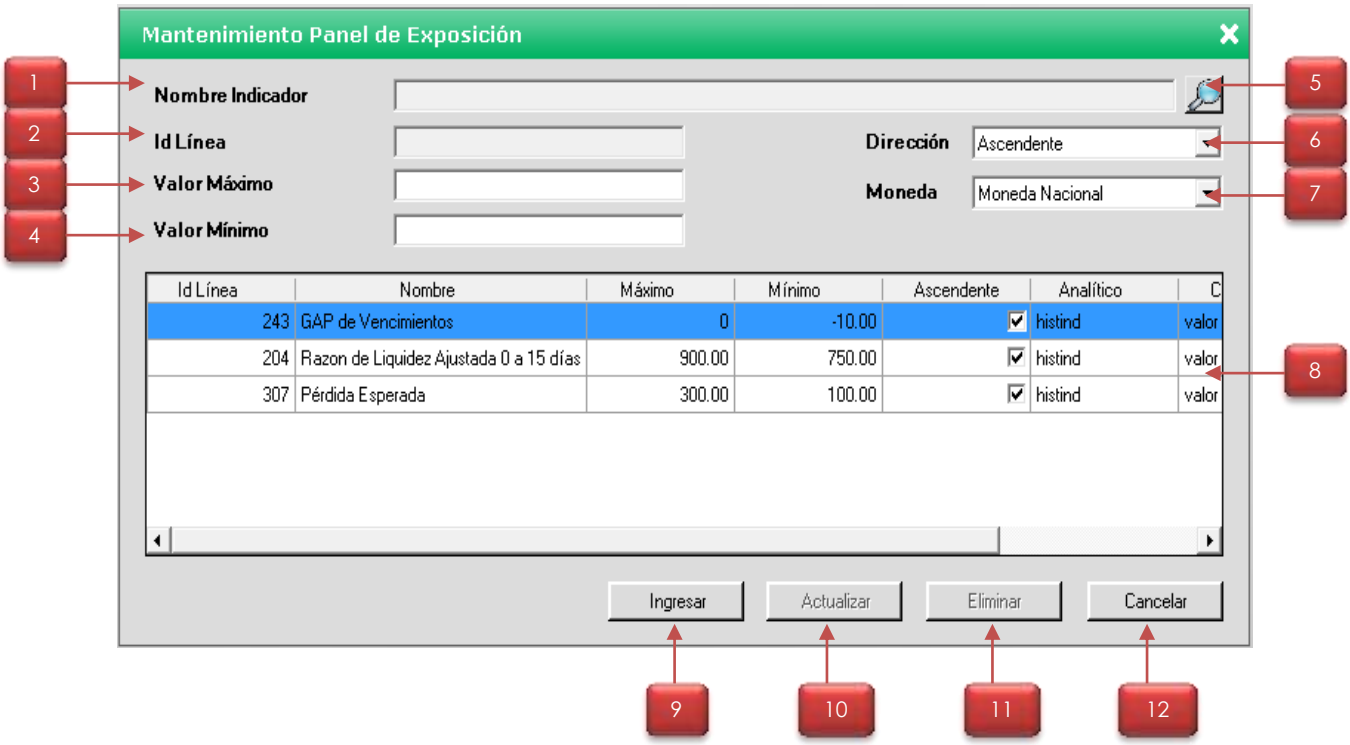
6. Aplicar: Permite guardar los cambios realizados en la configuración del reporte.

Pasos para utilización:

1. Abra la pantalla de configuración de Reportes ubicada en el menú de configuración.
2. Seleccione el nombre de la compañía.
3. Haga clic sobre el botón buscar y dentro de la pantalla que se muestra digite el nombre del reporte que desea configurar, seleccione el panel inferior de resultados el reporte deseado.
4. Se mostrará en el Grid los campos que componen el reporte, si existen campos que no desea exportar haga clic derecho sobre el campo y elimine el campo no requerido.
5. Dentro del grid sobre el campo “Descripción” digite el nombre de la etiqueta del campo y realice esta misma acción con cada campo que desea exportar.
6. Tras completar los puntos anteriores haga clic en Aplicar para guardar los cambios y la configuración realizada.
7. En caso que desee modificar la configuración solo deberá repetir el proceso descrito anteriormente.

2.6. Mantenimiento Panel de Exposición.

Esta pantalla permite agregar, editar o eliminar los indicadores incluidos en la pantalla de Panel de exposición.



Opciones de Pantalla:

1. Nombre Indicador: Corresponde al nombre del indicador que se sea incluir.

2. ID Línea: Corresponde al número interno asignado al indicador.

3. Valor Máximo: Corresponde al valor máximo de exposición del indicador, a partir del que la institución considera que ha excedido el límite de exposición.

4. Valor Mínimo: Corresponde al valor mínimo de exposición.

5. Botón Buscar: Permite buscar dentro de la lista de indicadores el indicador que serán incluido dentro del monitoreo regular.

6. Dirección: Corresponde a la orientación del indicador respecto a la exposición. Ascendente: a medida que el indicador crece, crece también el nivel de exposición. Descendente: representa que en la medida que el indicador sea más pequeño mayor será la exposición. En resumen la dirección representa el comportamiento de valor del indicador y su relación con la exposición a riesgo.

7. Moneda: Permite seleccionar la moneda a la que será asociado el indicador.

8. Grid: Muestra los indicadores incluidos.

9. Ingresar: Permite agregar el indicador según los valores seleccionados.

10. Actualizar: Permite actualizar los valores asociados al indicador.

11. Eliminar: Permite eliminar el indicador creado previamente.

12. Cancelar: Permite cancelar el proceso de registro o edición del indicador.

Pasos para agregar un nuevo indicador.

1. Seleccione la opción Mantenimiento Panel de Exposición incluido en el menú de Configuración.
2. Haga clic sobre el botón Buscar y seleccione el indicador que desea agregar.
3. Digite el valor máximo y mínimo de exposición, así como la orientación o dirección de la exposición.
4. Seleccione la moneda asociada con los valores digitados.
5. Haga clic en Ingresar.
6. El sistema le confirmará mediante mensaje la inclusión satisfactoria.

Pasos para editar un indicador existente.

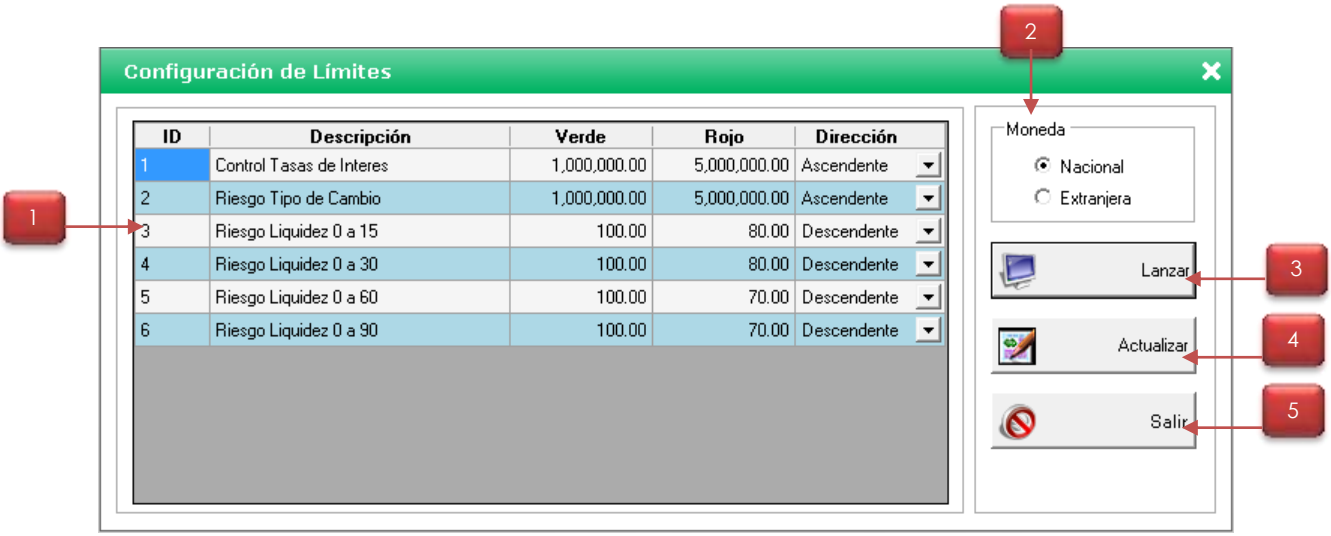
1. Seleccione la opción Mantenimiento Panel de Exposición incluido en el menú de Configuración.
2. Seleccione del Grid el indicador que desea editar.
3. Modifique los valores según su requerimiento.
4. Haga clic en el botón actualizar.
5. El sistema le confirmará mediante mensaje la edición satisfactoria.

Pasos para eliminar un indicador.

1. Seleccione la opción Mantenimiento Panel de Exposición incluido en el menú de Configuración.
2. Seleccione del Grid el indicador que desea borrar.
3. Haga clic en el botón Eliminar.
4. El sistema le confirmará mediante mensaje la eliminación satisfactoria del indicador seleccionado.

2.7. Configuración de Límites.

Esta pantalla permite establecer los límites de exposición para el Valor en Riesgo de Tasas de Interés, Valor en Riesgo de Tipo de Cambio y Razón de Liquidez Ajustada.



Opciones de Pantalla:

1. **Grid con límites:**En esta pantalla se muestran los indicadores y los límites inferiores y superiores establecidos.
2. **Moneda:** Permite visualizar la moneda a la que corresponden los limites.
3. **Lanzar:** Permite consultar los limites.
4. **Actualizar:** Permite modificar el valor de los límites.
5. **Salir:** Permite cerrar la pantalla y suspender la tarea de consulta o edición.

Pasos para editar los límites:

1. Abra la pantalla de Configuración de Limites incluida en el Menú de Configuración.
2. Seleccione la moneda para la que desea editar los límites.
3. Haga clic en el botón Lanzar.
4. Modifique directamente sobre el grid el valor de los límites.
5. Seleccione la orientación del indicador. En caso que a mayor valor mayor exposición seleccione Ascendente. En caso que a menor valor del indicador mayor nivel de exposición selecciones descendente.
6. Al concluir la edición haga clic sobre el botón Actualizar para guardar los cambios.

3. Menú Riesgo de Crédito

3.1. Reportes de Crédito

Una vez que el usuario haya completado la carga de información y transformado los datos utilizando el RiskDWtools puede seleccionar la opción de Riego de Créditodonde tendrá disponible la opción de visualizar los resultados mediante la exportación a Excel. Al abrir la pantalla tendrá las siguientes opciones:

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial de los reportes o indicadores que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información de los reportes. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que desea visualizar, existen diferentes agrupaciones. (En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las estas agrupaciones, así como los reportes incluidos en cada una, y una reseña del objetivo del informe o indicador).

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Este check permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones consulte el manual de usuario del RiskDwtools, en la sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Este botón permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

8. Botón XML: Este botón permite la exportación del reporte a XML según los parámetros seleccionados en la pantalla y la configuración definida para el reporte en la pantalla de Configuración de Reportes XML.

Pasos para su utilización:

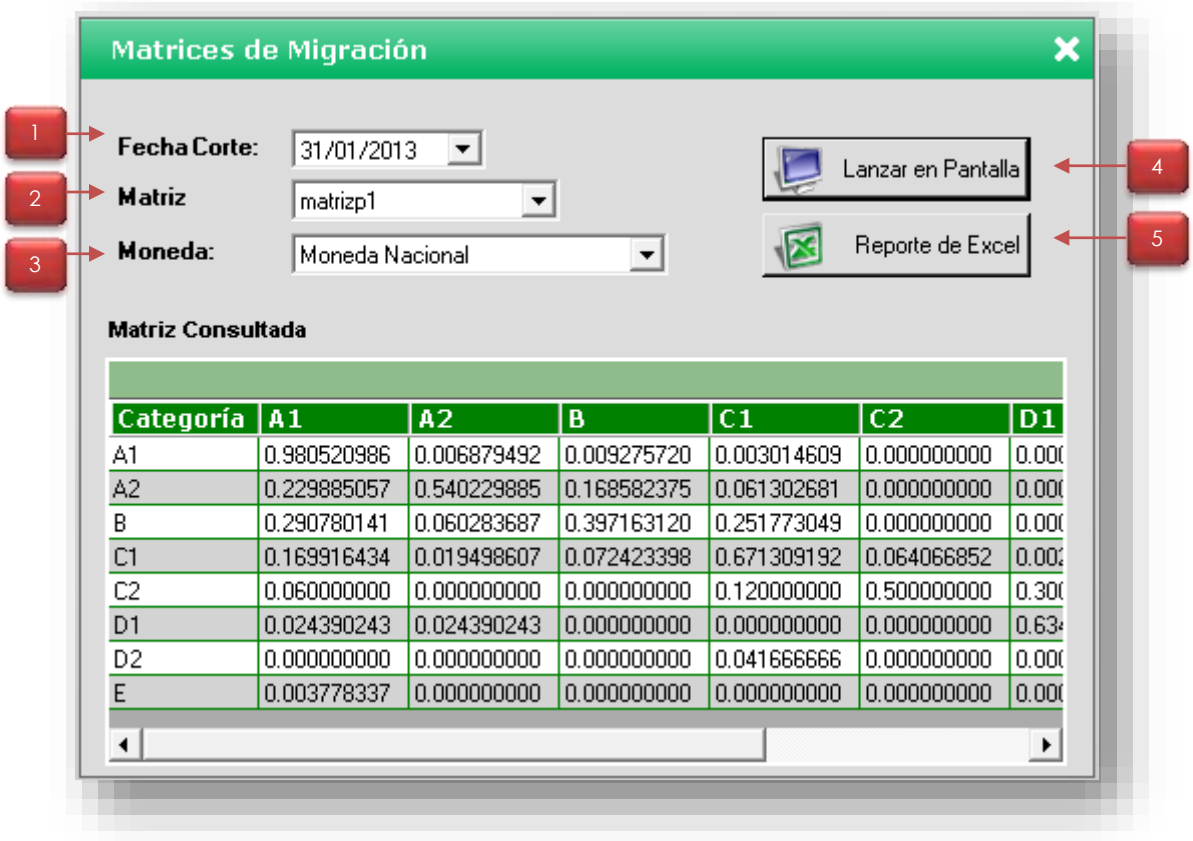
1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.
6. Por defecto, el Check de Simulación está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario, deberá seleccionar el check de simulación y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón “Excel” o “XML” para solicitar la exportación de los resultados del reporte.
8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande, el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

3.2. Matrices de migración.

En esta pantalla, el usuario podrá visualizar los resultados de la matriz de migración P1 (Matrices General porcentual por calificación del Cliente) y la Matriz P2 (Matrices General porcentual según morosidad). Los resultados de la matriz se podrán visualizar en pantalla y podrán exportarse a Excel.

La visualización de los resultados requiere previo la generación de la matriz de migración desde el RiskDwtools.

A continuación, la pantalla y sus opciones:



1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha a la que desean visualizar los resultados.

2. Matriz: Corresponde a la matriz que desea visualizar.

3. Moneda: Corresponde la moneda para la que genera reportes.

4. Botón Lanzar a Pantalla: Permite la visualización de los resultados a la pantalla del sistema.

5. Reporte a Excel: Permite la exportación de los resultadosa Excel.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte de la información que desea visualizar.
3. Seleccione la matriz.
4. Seleccione la moneda.
5. Haga clic en mostrar a pantalla o exportar a Excel según lo requiera.

3.3. Pérdida Esperada.

Esta pantalla permite la visualización de las pérdidas esperadas basadas en la utilización de la matriz P1, los saldos de las operaciones, la calificación del cliente y la garantía y otros aspectos que se mezclan dentro del modelo para estimar el monto sujeto a pérdida, como resultado del comportamiento del pago del cliente sobre la cartera de crédito. Para más detalles sobre el modelo y la forma de su aplicación consulte el Manual de Modelos, Sección Pérdida Espera.
La visualización de resultados requiere desde el RiskDwtools la generación de los reportes de riesgo de liquidez, el matriz de migración y la generación de los reportes de riesgo de crédito.

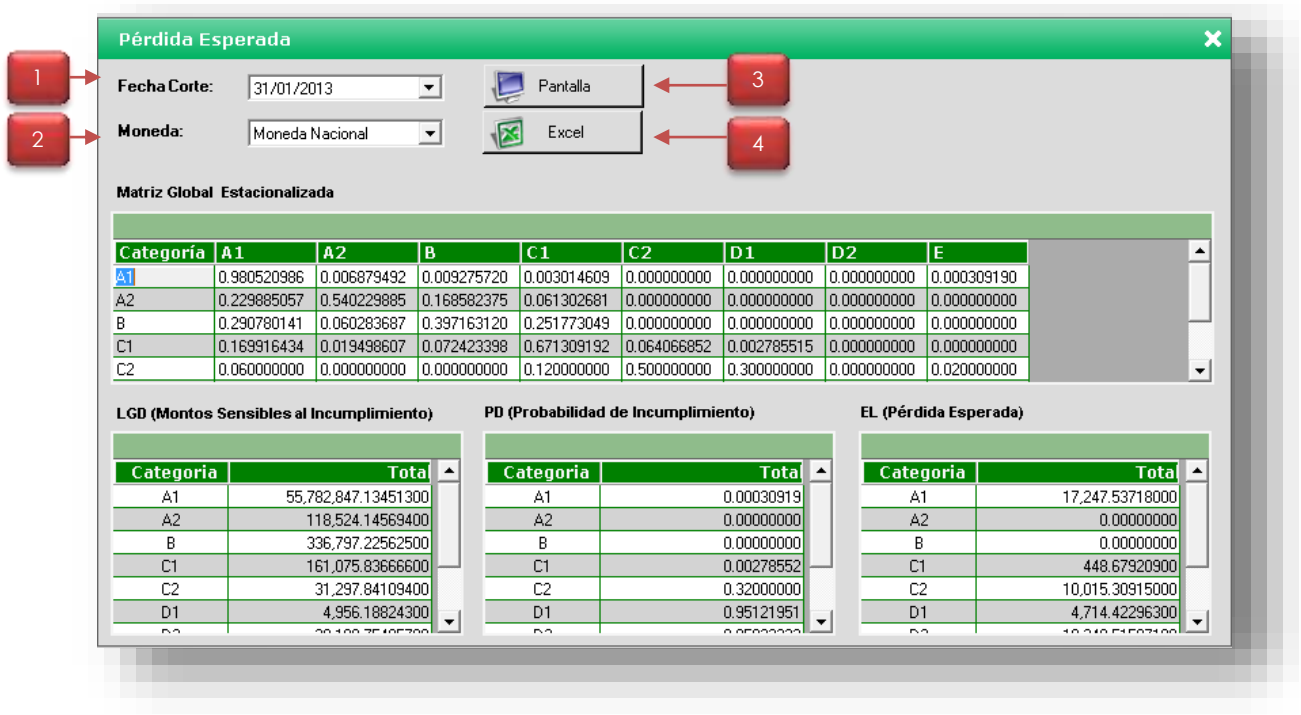
A continuación se muestran los botones que componen la pantalla de “Pérdida Esperada” donde se expone la manera en la que los usuarios podrán hacer uso de esta pantalla.

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha de corte que desea visualizar.

2. Moneda: Corresponde a la moneda del reporte.

3. Pantalla: Permite la visualización de los resultados a pantalla.

4. Excel: Permite la exportación de resultados a Excel.



Pasos para su utilización:

6. Abra la pantalla.
7. Seleccione la fecha de corte.
8. Seleccione la moneda.
9. Haga *clic* en "Pantalla" si desea visualizar los resultados en la pantalla del sistema, o "Excel" si desea exportar los resultados a Microsoft Excel ®.

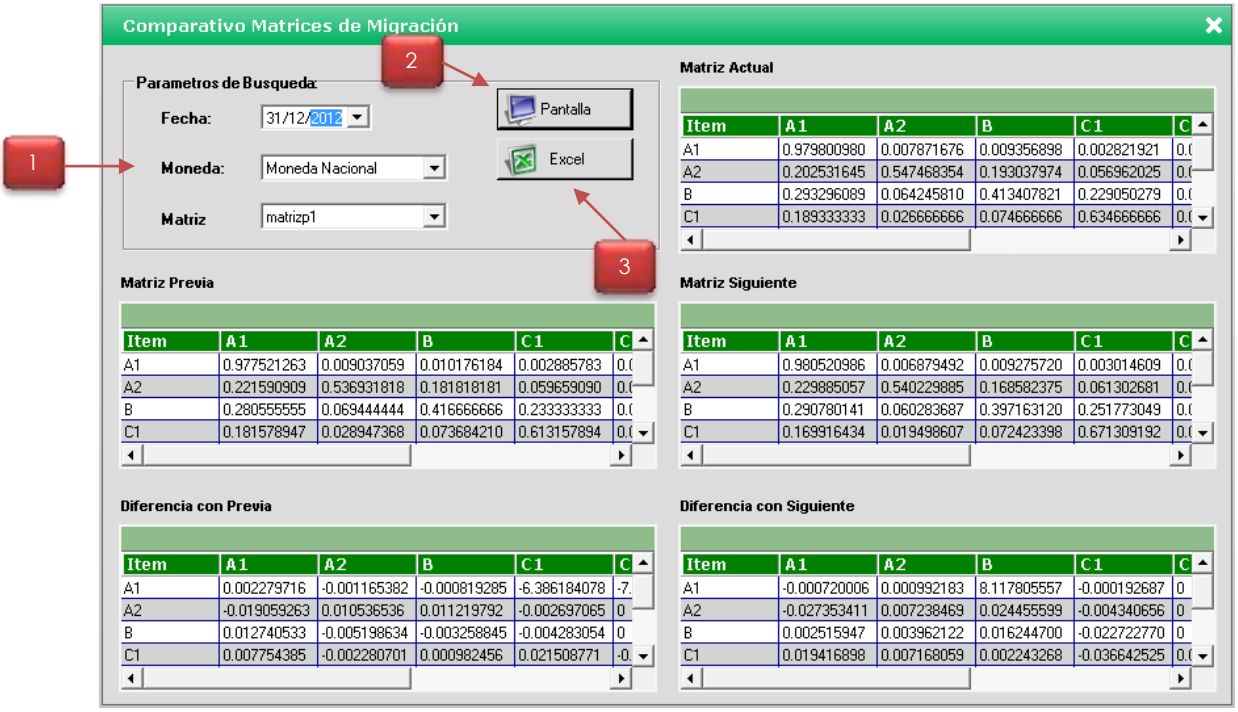
3.4. Comparativo Matrices de Migración.

Esta pantalla permite visualizar y comparar la evolución que ha tenido la matriz de migración generada a la fecha corte, respecto a su matriz posterior y anterior. Así por ejemplo, si se selecciona 31 de diciembre de 2012, el sistema comparará los resultados de la contra la matriz futura, 31 de enero de 2013 y pasada 30 de noviembre de 2012. En la pantalla se mostrarán las diferencias entre los resultados con la matriz previa e igualmente con la próxima matriz, o la matriz siguiente.

Para utilizar esta pantalla es necesario contar con la generación de la matriz para la fecha de corte, también un mes previo y un mes adelante, respecto a la fecha de corte. Para

más información sobre el mecanismo de generación de la matriz de migración consulte el Manual de Usuario del RiskDWtools, en la sección Matriz de Migración.

Dentro de la pantalla el usuario encontrará las siguientes opciones:



Fecha de Corte: Corresponde a la fecha de corte que desea visualizar los resultados.

1. Moneda: Corresponde a la moneda del reporte.

2. Pantalla: Permite la visualización de los resultados a pantalla.

3. Excel: Permite la exportación de resultados a Excel.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte.
3. Seleccione la moneda.
4. Haga *clic* en "Pantalla" si desea visualizar los resultados en la pantalla del sistema, o "Excel" si desea exportar los resultados a Microsoft Excel ®.

3.5. Reporte de Categorías y Criterios de Riesgo.

En esta pantalla, el usuario podrá generar reportes sobre la composición de la cartera de préstamos considerando la clasificación del riesgo del cliente, y la composición por criterio (Mayores Deudores, Menores Deudores, Pymes, Consumo y Vivienda)

Los campos que componen esta pantalla se describen a continuación, así como la manera en la que los usuarios podrán utilizar esta función.

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha de corte que desea visualizar los resultados.

2. Moneda: Corresponde a la moneda del reporte.

3. Pantalla: Permite la visualización de los resultados a pantalla.

4. Excel: Permite la exportación de resultados a Excel.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.

2. Seleccione la fecha de corte.
3. Seleccione la moneda.
4. Haga *clic* en "Pantalla" si desea visualizar los resultados en la pantalla del sistema, o "Excel" si desea exportar los resultados a Microsoft Excel ®.
5. Para mejor comprensión se detallan los códigos de las categorías:
    - 1A – Mayores Deudores Comerciales.
    - 1B – Menores Deudores Comerciales.
    - 1C – Pymes.
    - 2A – Consumo.
    - 3A – Créditos para la Vivienda.

3.6. Créditos por Sectores Económicos.

Esta pantalla permite visualizar la composición de la cartera de préstamos por sectores económicos.

Los campos que componen esta pantalla se describen a continuación, así como la manera en la que los usuarios podrán utilizar esta función.

1. **Fecha de Corte:** Corresponde a la fecha de corte que desea visualizar los resultados.

2. Moneda: Corresponde a la moneda del reporte.

3. Pantalla: Permite la visualización de los resultados a pantalla.

4. Excel: Permite la exportación de resultados a Excel.

Pasos para su utilización:

6. Abra la pantalla.
7. Seleccione la fecha de corte.
8. Seleccione la moneda.
9. Haga *clic* en "Pantalla" si desea visualizar los resultados en la pantalla del sistema, o "Excel" si desea exportar los resultados a Microsoft Excel ®.

4. Menú Riesgo de Mercado.

4.1. Reportes de Mercado

Una vez que el usuario haya completado la carga de información y haya transformado los datos utilizando el RiskDWtools, puede seleccionar la opción de Riego de Mercado, donde tendrá disponible la opción de visualizar los resultados mediante la exportación a Excel. Al abrir la pantalla tendrá las siguientes opciones:

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información, en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que desea visualizar, existen diferentes agrupaciones, (En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las

agrupaciones,así como los reportes incluidos en cada una y la reseña del objetivo del informe o indicador).

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones, consulte el manual de usuario del RiskDwtools sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

8. Botón XML: Este botón permite la exportación del reporte a XML según los parámetros seleccionados en la pantalla y la configuración definida para el reporte en la pantalla de Configuración de Reportes XML.

Pasos para su utilización:

10. Abra la pantalla.
11. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
12. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
13. Seleccione la agrupación.
14. Seleccione el reporte.
15. Por defecto, el “Check de Simulación” está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario, deberá seleccionar el check de simulación y deberá seleccionar la simulación de su interés.
16. Haga *clic* en el botón “Excel” o “XML”para solicitar la exportación de los resultados al reporte.
17. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

4.2. Modelación Paramétrica

Alternativamente, el usuario podrá generar los reportes bajo modelación paramétrica, bajo esta modalidad en el reporte de salida o plantilla son incorporadas las principales fórmulas de cálculo empleadas para generar el indicador. De tal forma que el usuario podrá modificar la información que compone el reporte, al tiempo que visualiza los resultados del indicador recalculado.

Para utilizar esta pantalla el usuario debe, desde el RiskDwtools, cargar las plantillas de información, actualizar las tasas de cambio, las tasas de interés y procesar los reportes de Riesgo de Mercado. Para mayor información, refiérase al Manual de usuario del RiskDwtools, sección Riesgo de Mercado.

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que se desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que se desea visualizar, existen diferentes agrupaciones(En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las agrupaciones así como los reportes incluidos en cada una y la reseña del objetivo del informe o indicador).

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que se desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones, consulte el manual de usuario del RiskDwtools sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.
6. Por defecto el “Check de Simulación” está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario, deberá seleccionar el check de simulación, y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón “Excel” para solicitar la exportación de los resultados al reporte.
8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

4.3. Simulación Montecarlo.

En esta pantalla el usuario podrá generar emplear el modelo estadístico de Montecarlo para las viables que haya cargado desde el RiskDwtools. Para más información sobre la creación de variables y actualización, refiérase al Manual de Usuario del RiskDwtools sección Master Variables, y Actualización de Variables.

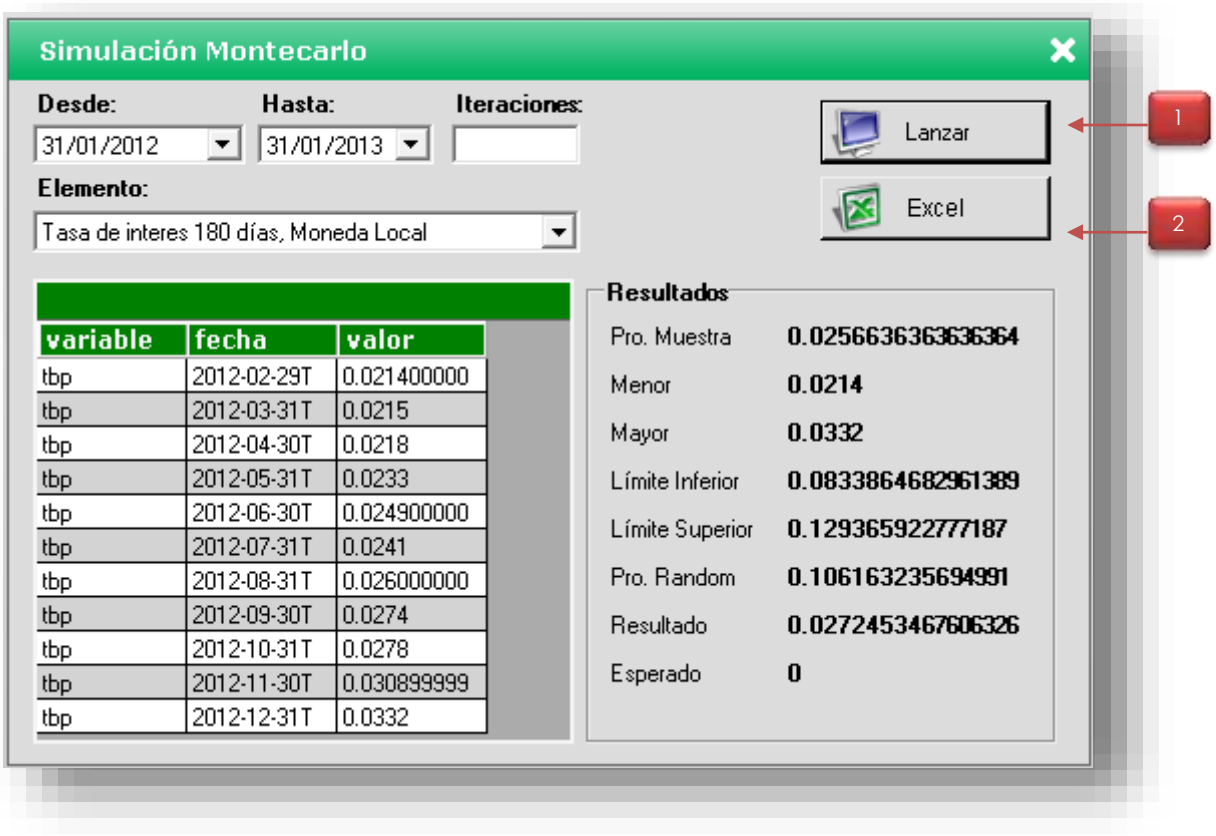
A continuación, se muestra la pantalla de "Simulación Montecarlo" así como los campos que componen la pantalla, de modo que se facilite la compresión de la pantalla y cómo se usa.

Campos de la Pantalla:

Desde: Fecha inicial del rango de información histórica que será considerada en la Simulación Montecarlo.

Hasta: Fecha final del rango de información histórica que será considerada en la Simulación Montecarlo.

Iteraciones: Corresponde al número de simulación que el sistema realizará, por defecto se emplean 5000 simulaciones sin embargo; el usuario podrá incrementar o disminuir el número.



1. Botón Lanzar: Permite la visualización de los resultados a pantalla.

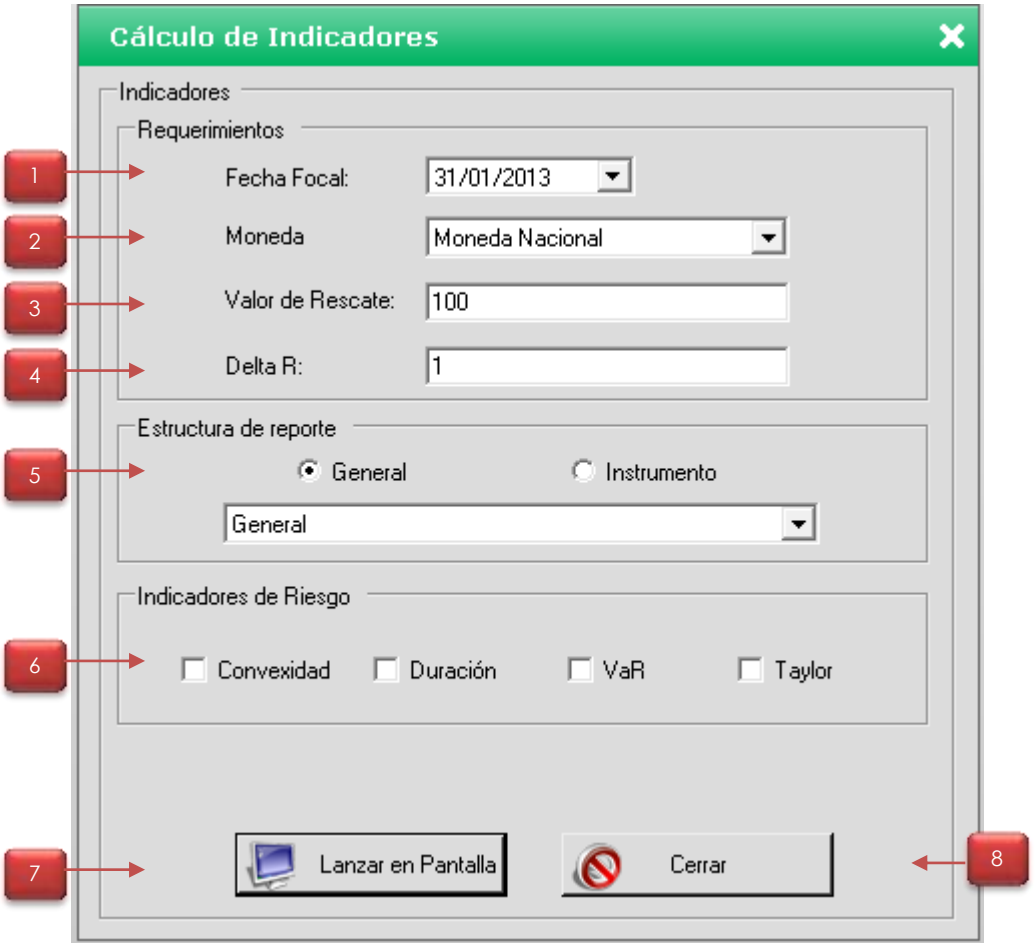
2. Excel: Permite la exportación de los resultados a Excel.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha desde.
3. Seleccione la fecha hasta.
4. Seleccione el número de interacciones o escenarios.
5. Seleccione la variable que desea simular.
6. Haga *clic* en el "botón" lanzar para que el sistema realice los cálculos y los muestre la pantalla.
7. Haga *clic* en el botón "Excel" o "XML" para solicitar la exportación de los resultados al reporte.

4.4. Cálculo de Indicadores.

Esta pantalla permite la generación y consulta de indicadores sobre la cartera de inversiones como la duración, aproximación de Taylor o el cálculo del Valor en Riesgo.



A continuación el detalle de los botones y campos que componen la pantalla:

1. **Fecha Focal:** Permite seleccionar la fecha a la que se desea generar el reporte.
2. **Moneda:** Permite seleccionar la moneda de las inversiones que se desean consultar.
3. **Valor de Rescate:** Permite seleccionar el valor de rescate de la inversión.
4. **Delta de R:** Permite seleccionar el valor de rescate.
5. **Generar o Instrumento:** Permite seleccionar si el reporte será general o se realizará por instrumento.
6. **Indicadores de Riesgo:** Permite la selección del indicador que se desea generar. Sea convexidad, duración VaR y Aproximación de Taylor.

7. **Lanzar en Pantalla:** Permite generar el reporte.
8. **Cerrar:** Permite cerrar la pantalla.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla de Cálculo de Indicadores incluida en el menú de Riesgo de Mercado.
2. Seleccione la fecha focal en la que desea generar el reporte.
3. Haga clic en el botón Generar Reporte.

5. Menú Riesgo de Liquidez.

5.1. Reportes de Liquidez

Para utilizar esta pantalla, el usuario debe, desde el RiskDwtools, cargar las plantillas de información, actualizar las tasas de cambio y procesar los reportes de Riesgo de Liquidez y Concentración de las Captaciones. Para mayor información, refiérase al Manual de usuario del RiskDwtools, en la sección de Riesgo de Liquidez/Riesgo de Concentración de las Captaciones.

Una vez que el usuario haya completado los pasos señalados,tendrá disponible la opción de visualizar los resultados mediante la exportación a Excel. Al abrir la pantalla tendrá las siguientes opciones:

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que se desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que se desea visualizar, existen diferentes agrupaciones.(En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las agrupaciones así como los reportes incluidos en cada una y la reseña del objetivo del informe o indicador).

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Este *check* permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones, consulte el manual de usuario del RiskDwtools sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

8. Botón XML: Este botón permite la exportación del reporte a XML según los parámetros seleccionados en la pantalla y la configuración definida para el reporte en la pantalla de Configuración de Reportes XML.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.
6. Por defecto el “Check de Simulación está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario deberá seleccionar el check de simulación, y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón “Excel” o “XML”para solicitar la exportación de los resultados al reporte.

8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

6. Menú Riesgo Operacional.

6.1. Reportes de Operacional

Para utilizar esta pantalla, el usuario debe, desde el RiskOp, cargar lainformación de los eventos de riesgo operacional. Para mayor información, refiérase al Manual de usuario del RiskOP.

Una vez que el usuario haya completado los pasos señalados, tendrá disponible la opción de visualizar los resultados mediante la exportación a Excel o XML. Al abrir la pantalla tendrá las siguientes opciones:

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que se desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que se desea visualizar, existen diferentes agrupaciones. (En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las agrupaciones así como los reportes incluidos en cada una y la reseña del objetivo del informe o indicador).

5. Selección del Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Este *check* permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones, consulte el manual de usuario del RiskDwtools sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

8. Botón XML: Este botón permite la exportación del reporte a XML según los parámetros seleccionados en la pantalla y la configuración definida para el reporte en la pantalla de Configuración de Reportes XML.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.

3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.
6. Por defecto el "Check de Simulación está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario deberá seleccionar el check de simulación, y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón "Excel" o "XML" para solicitar la exportación de los resultados al reporte.
8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

6.2. Modelación Paramétrica

Alternativamente, el usuario podrá generar los reportes bajo modelación paramétrica, bajo esta modalidad en el reporte de salida o plantilla son incorporadas las principales fórmulas de cálculo empleadas para generar el indicador. De tal forma que el usuario puede modificar la información que compone el reporte, al tiempo que visualiza los resultados del indicador recalculado.

Para utilizar esta pantalla, el usuario debe desde el RiskDwtools cargar las plantillas de información, actualizar las tasas de cambio y procesar los reportes de Riesgo Liquidez. Para mayor información, refiérase al Manual de usuario del RiskDwtools, en la sección Riesgo de Liquidez.

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que se desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que se desea visualizar, existen diferentes agrupaciones.(En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las agrupaciones, así como los reportes incluidos en cada agrupación, y una reseña del objetivo del informe o indicador).

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que se desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Este *check* permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones consulte el manual de usuario del RiskDwtools, en la sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.

6. Por defecto el *check* de Simulación está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario, deberá seleccionar el check de simulación, y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón "Excel"para solicitar la exportación de los resultados al reporte.
8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

7. Otros Reportes.

7.1. Reporte de Financiamientos.

Para utilizar esta pantalla el usuario debe desde el RiskDwtools cargar las plantillas de información, actualizar las tasas de cambio y procesar los reportes de Análisis de Financiamientos. Para mayor refiérase al Manual de usuario del RiskDwtools, en la sección Análisis de Financiamientos.

Una vez que el usuario haya completado los pasos señalados, tendrá disponible la opción de visualizar los resultados mediante la exportación a Excel. Al abrir la pantalla tendrá las siguientes opciones:

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que se desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que se desea visualizar, existen diferente agrupación, en el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las agrupaciones así como los reportes incluidos en cada agrupación, y una reseña del objetivo del informe o indicador.

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que se desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Este *check* permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones consulte el manual de usuario del RiskDwtools, en la sección "Configuración de Escenarios".

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

8. Botón XML: Este botón permite la exportación del reporte a XML según los parámetros seleccionados en la pantalla y la configuración definida para el reporte en la pantalla de Configuración de Reportes XML.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.
6. Por defecto, el Check de Simulación está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario, deberá seleccionar el check de simulación, y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón "Excel" o "XML"para solicitar la exportación de los resultados al reporte.

8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande, el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

7.2. Reporte de Captaciones.

Para utilizar esta pantalla el usuario debe, desde el RiskDwtools, cargar las plantillas de información, actualizar las tasas de cambio y procesar los reportes de Análisis de Captaciones. Para mayor información, refiérase al Manual de usuario del RiskDwtools, en la sección Análisis de Captaciones.

Una vez que el usuario haya completado los pasos señalados, tendrá disponible la opción de visualizar los resultados mediante la exportación a Excel. Al abrir la pantalla tendrá las siguientes opciones:

Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que se desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que se desea visualizar, existen diferentes agrupaciones (En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las agrupaciones así como los reportes incluidos en cada una y la reseña del objetivo del informe o indicador).

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Este check permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargada y generada. Para más información sobre las simulaciones, consulte el manual de usuario del RiskDwtools en la sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

8. Botón XML: Este botón permite la exportación del reporte a XML según los parámetros seleccionados en la pantalla y la configuración definida para el reporte en la pantalla de Configuración de Reportes XML.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.
6. Por defecto, el Check de Simulación está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario, deberá seleccionar el check de simulación y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón “Excel” o “XML”para solicitar la exportación de los resultados al reporte.

8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande, el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

7.3. Reporte de Inversiones

Para utilizar esta pantalla el usuario debe, desde el RiskDwtools, cargar las plantillas de información, actualizar las tasas de cambio y procesar los reportes de Análisis de las Inversiones. Para mayor información, refiérase al Manual de usuario del RiskDwtools, en la sección Análisis de las Inversiones.

Una vez que el usuario haya completado los pasos señalados, tendrá disponible la opción de visualizar los resultados mediante la exportación a Excel. Al abrir la pantalla tendrá las siguientes opciones:

1. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha inicial del reporte o indicador que desea consultar.

2. Hasta: Corresponde a la fecha hasta cuando se desea visualizar la información del reporte o indicador. Esta opción no está disponible para todos los reportes y se activará siempre que el reporte permita la generación de información en un rango de fechas.

3. Moneda: Esta opción permite seleccionar la moneda del reporte que se desea visualizar.

4. Agrupaciones: Corresponde a la agrupación del reporte que se desea visualizar, existen diferentes agrupaciones.(En el Anexo No. 1 se incluye un desglose de las agrupaciones, así como los reportes incluidos en cada una y la reseña del objetivo del informe o indicador.

5. Selecciónde l Reporte: Esta opción permite seleccionar el reporte específico que se desea visualizar.

6. Check Reporte Simulación: Este check permite seleccionar los resultados con base en una simulación previamente cargar y generada. Para más información sobre las simulaciones, consulte el manual de usuario del RiskDwtools en la sección Configuración de Escenarios.

7. Botón Excel: Permite la exportación del reporte a Excel según los parámetros seleccionados en la pantalla.

8. Botón XML: Este botón permite la exportación del reporte a XML según los parámetros seleccionados en la pantalla y la configuración definida para el reporte en la pantalla de Configuración de Reportes XML.

Pasos para su utilización:

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la fecha de corte del reporte que desea visualizar.
3. Seleccione la moneda del reporte que desea visualizar.
4. Seleccione la agrupación.
5. Seleccione el reporte.
6. Por defecto el Check de Simulación está desactivado. Si desea visualizar un reporte normal no deberá modificarlo. En caso contrario, deberá seleccionar el check de simulación, y deberá seleccionar la simulación de su interés.
7. Haga *clic* en el botón “Excel” o “XML”para solicitar la exportación de los resultados al reporte.

8. El proceso de exportación varía en función del número de registros que contenga el reporte. Si el número de registros del reporte es muy grande, el sistema le solicitará confirmar su interés en generar un reporte con más de siete mil registros.

7.4. Matrices y Archivos de Cálculo.

Para facilitar el proceso de verificación y/o confirmación de los resultados el usuario dispone de la pantalla de Matrices y Archivos de Cálculo, en esta pantalla se podrán generar los resultados detallados del bandeo de las operaciones tanto a nivel de vencimientos como de reprecios que dan pie a la conformación de los indicadores o reportes.

Para utilizar esta pantalla es necesaria la generación de los reportes desde el RiskDwtools.

Opciones de la Pantalla:

1. **Compañía: Corresponde** al nombre de la empresa para la que se desea visualizar las matrices o archivos de cálculo.

2. Fecha de Corte: Corresponde a la fecha que se desea visualizar las matrices o archivos de cálculo.

3. Moneda: Corresponde a la moneda del reporte que desea generar.

4. Riesgo: Corresponde a la agrupación de las matrices por tipo de riesgo, Riesgo de Mercado o Riesgo de Liquidez.

5. Agrupación: Corresponde a la agrupación del reporte que desea visualizar. (Se incluye en el Anexo No.1 un detalle de las agrupaciones así como los reportes por agrupación).

6. Reporte: Corresponde a la matriz específica que se desea visualizar.

7. Abrir: Permite visualizar los resultados de la selección previa.

Pasos para su uso

1. Abra la pantalla.
2. Seleccione la compañía.
3. Seleccione la fecha de corte.
4. Seleccione la moneda
5. Seleccione el Riesgo.
6. Seleccione la Agrupación.
7. Seleccione el Reporte.
8. Haga *clic* en “abrir”.

7.5. Abrir Cubos (Opción disponible según licenciamiento)

Esta opción permite la apertura y consulta de los cubos de información. Al hacer un *clic* sobre la opción del menú se abrirá su navegador de internet predeterminado y a continuación, el sistema le solicitará los datos sus credenciales de acceso. Completado el proceso de registro podrá navegar, crear o generar reportes.

8. Menú: Panel de Exposición.

8.1. Panel de Exposición a una fecha de corte.

Esta pantalla permite visualizar mediante una escala de 3 colores, rojo, amarillo y verde el nivel de exposición asumido, según los límites configurados en la pantalla de Mantenimiento de Panel de Exposición (Para más información consulte la sección 2.6)

Opciones de Pantalla:

1. **Fecha de Corte:** Permite seleccionar la fecha de los indicadores que se mostrará en pantalla.
2. **Moneda:** Permite seleccionar la moneda de los indicadores que se desea consultar.
3. **Simulación:** Permite seleccionar si los valores de los indicadores serán los normales o los simulados.
4. **Botón Generar:** Permite cargar la información a pantalla según los parametros seleccionados.

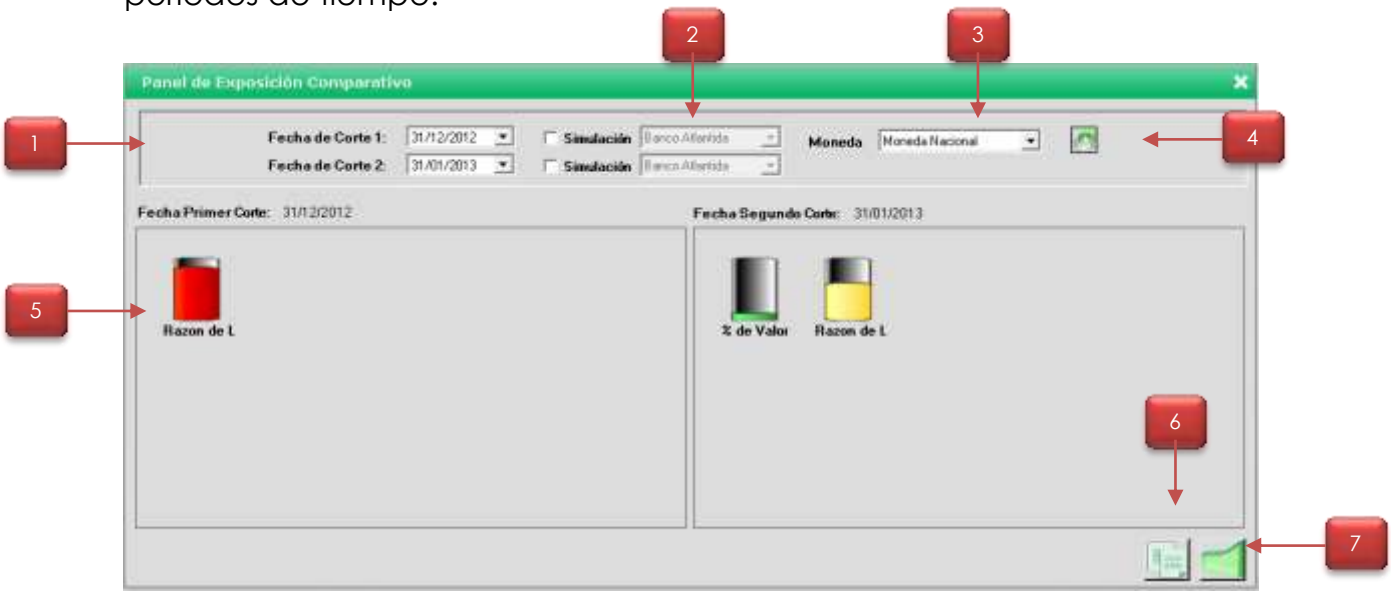
5. **Grid con indicadores:** Dentro del Grid se cargarán los indicadores configurados previamente. Cada indicador mostrará en una escala de tres colores el nivel de exposición asumido; siento rojo: alta exposición, amarillo: exposición media, verde: baja exposición.
6. **Botón Copiar:** Permite copiar la información de los indicadores.

Pasos para la utilización de la Pantalla:

1. Abra la pantalla de Panel de Exposición, hay una Fecha de Corte incluida en el menú de Panel de Exposición.
2. Seleccione la fecha de corte que desea consultar.
3. Seleccione la moneda de los indicadores que desea consultar.
4. Seleccione la opción de Simulación si desea visualizar los resultados de una simulación.
5. Haga clic sobre el botón Generar para cargar los resultados a pantalla.
6. En caso que desee eliminar o agregar nuevos indicadores o modificar los límites de los indicadores consulte la sección 2.6 (Mantenimeinto Panel de Exposición)

8.2. Panel de Exposición comparativo.

Esta pantalla permite comparar los resultados de los indicadores en dos periodos de tiempo.



Opciones de Pantalla:

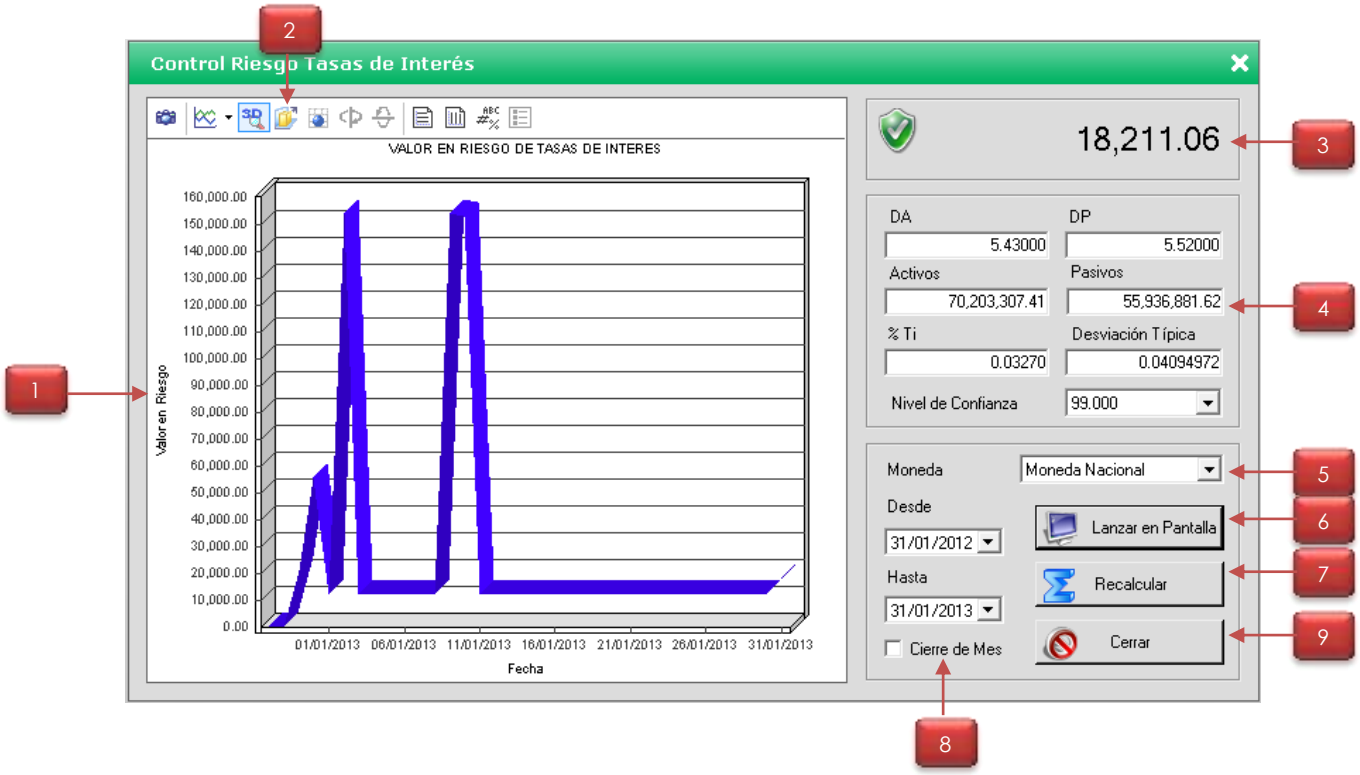
1. **Fecha de Corte 1 y Fecha de Corte 2:** Permite seleccionar las fechas que serán comparadas.
2. **Moneda:** Permite seleccionar la moneda de los indicadores que se desean consultar.
3. **Simulación:** Permite seleccionar si los valores de los indicadores serán los normales o los simulados.
4. **Botón Generar:** Permite cargar la información a pantalla según los parametros seleccionados.
5. **Grid con indicadores:** Dentro del Grid se cargarán los indicadores configurados previamente. Cada indicador mostrará en una escala de tres colores el nivel de exposición asumido; si es tono rojo: alta exposición, amarillo: exposición media, verde: baja exposición.
6. **Botón Copiar:** Permite copiar la información de los indicadores.
7. **Botón Ver Variaciones:** Permite identidicar el cambio porcentual de los indicadores entre los periodos comparados.

Pasos para la utilización de la Pantalla:

1. Abra la pantalla de Panel de Exposición a una Fecha de Corte incluida en el menú de Panel de Exposición.
2. Seleccione las fechas que desea comparar.
3. Seleccione la moneda de los indicadores que desea comparar.
4. Seleccione la opción de Simulación si desea visualizar los resultados de una simulación.
5. Haga clic sobre el botón Generar para cargar los resultados a pantalla.
6. Si desea visualizar las variaciones porcentuales entre los periodos y los indicadores cargados haga clic sobre el botón Ver Variaciones.
7. En caso que desee eliminar o agregar nuevos indicadores o modificar los límites de los indicadores consulte la sección 2.6 (Mantenimeinto Panel de Exposición)

8.3. Control Riesgo de Tasa de Interés.

Esta pantalla permite visualizar gráficamente el nivel de exposición actual e histórico del Valor en Riesgo de Tasas de Interés.



Opciones de Pantalla:

1. **Barra de Graficación:** Esta barra permite seleccionar el tipo de gráfico, modificar la posición y otras opciones de personalización del gráfico.
2. **Gráfico:** Muestra el comportamiento del indicador para el periodo seleccionado.
3. **Valor del Indicador:** Muestra el valor del indicador para la Fecha Hasta seleccionada.
4. **Datos de composición del Indicador:** Muestra los principales factores que dan pie al cálculo del indicador.
5. **Moneda:** Permite seleccionar la moneda del indicador que se desea visualizar.
6. **Lanzar a Pantalla:** Permite visualizar en pantalla el indicador deacuerdo con los parametros seleccionados.
7. **Recalcular:** Permite recalcular el indicador luego de realizar modificaciones en los factores que componen el indicador.

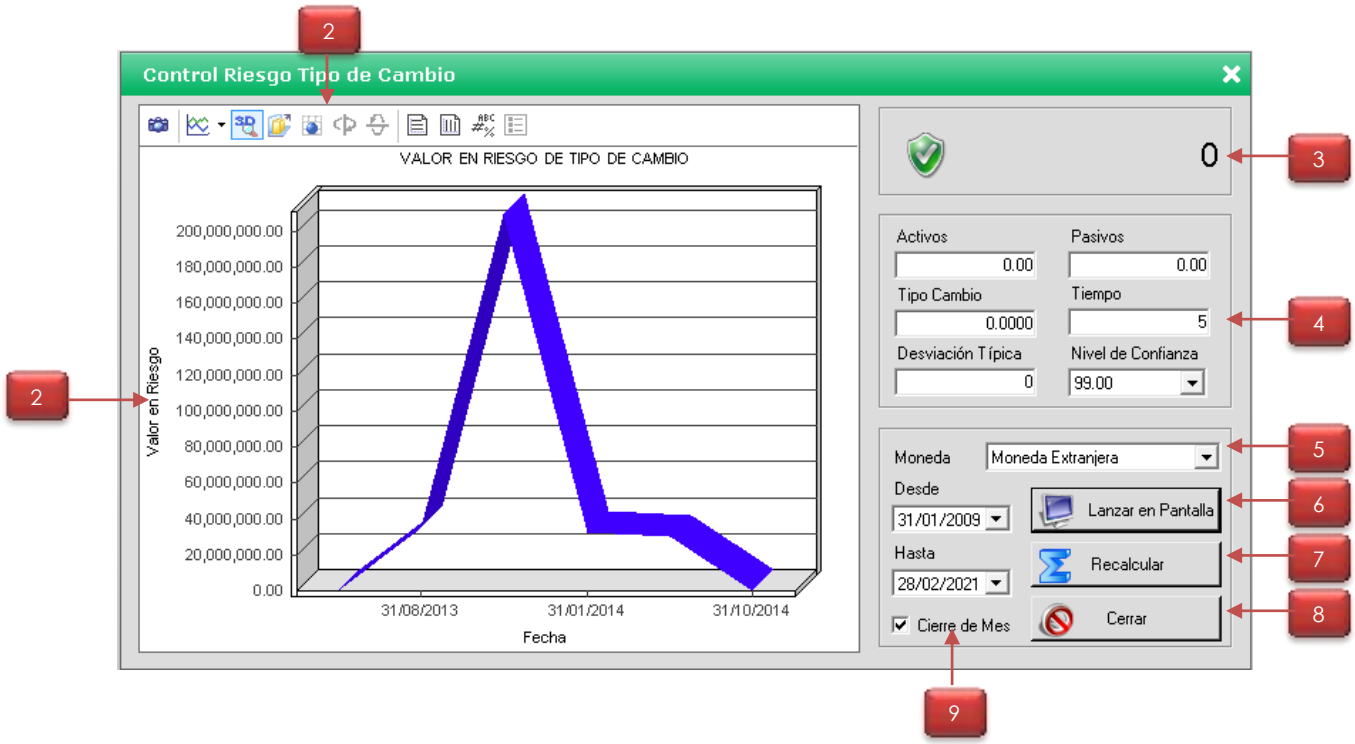
8. **Fechas y Cierre de Mes:** Permite seleccioanr el rango de tiempo en el que se desea visualizar el indicador. Es posible que el indicador se muestre solo para los cierres de mes, en tal caso se deberá seleccionar la opción Cierre de Mes.
9. **Cerrar:** Permite cerrar la pantalla.

Pasos para la utilización de la Pantalla:

1. Selecione la pantalla Control de Riesgo Tasas de Interés incluida en el Menú Panel de Exposición.
2. Seleccione el rango de fechas que desea consultar.
3. Seleccione la Moneda.
4. Si lo desea puede seleccionar la opción Cierre de Mes, con lo que el indicador solo se mostrará para los cierres de mes dentro del periodo de tiempo seleccionado.
5. Haga clic en el botón Lanzar.
6. Si lo desea puede modidicar la información de los factores, lo que le permitirá recalcular el indicador.
7. Recuerde que la información del indicador que se muestra en la sección superior de la pantalla corresponde al valor a la Fecha de Hasta.
8. Al lado del indicador se mostrará un indicador sobre el nivel de exposición asumido. Si lo desea podrá modificar los límites del indidcador. (Consulte Sección 2.7 Configuración de Límites.)

8.4. Control Riesgo de Tipo de Cambio.

Esta pantalla permite visualizar gráficamente el nivel de exposición actual e histórico del Valor en Riesgo de Tasas de Tipo de Cambio.



Opciones de Pantalla:

1. **Barra de Graficación:** Esta barra permite seleccionar el tipo de gráfico, modificar la posición y otras opciones de personalización del gráfico.
2. **Gráfico:** Muestra el comportamiento del indicador para el periodo seleccionado.
3. **Valor del Indicador:** Muestra el valor del indicador para la Fecha Hasta seleccionada.
4. **Datos de composición del Indicador:** Muestra los principales factores que dan pie al cálculo del indicador.
5. **Moneda:** Permite seleccionar la moneda del indicador que se desea visualizar.
6. **Lanzar a Pantalla:** Permite visualizar en pantalla el indicador deacuerdo con los parametros seleccionados.
7. **Recalcular:** Permite recalcular el indicador luego de realizar modificaciones en los factores que componen el indicador.

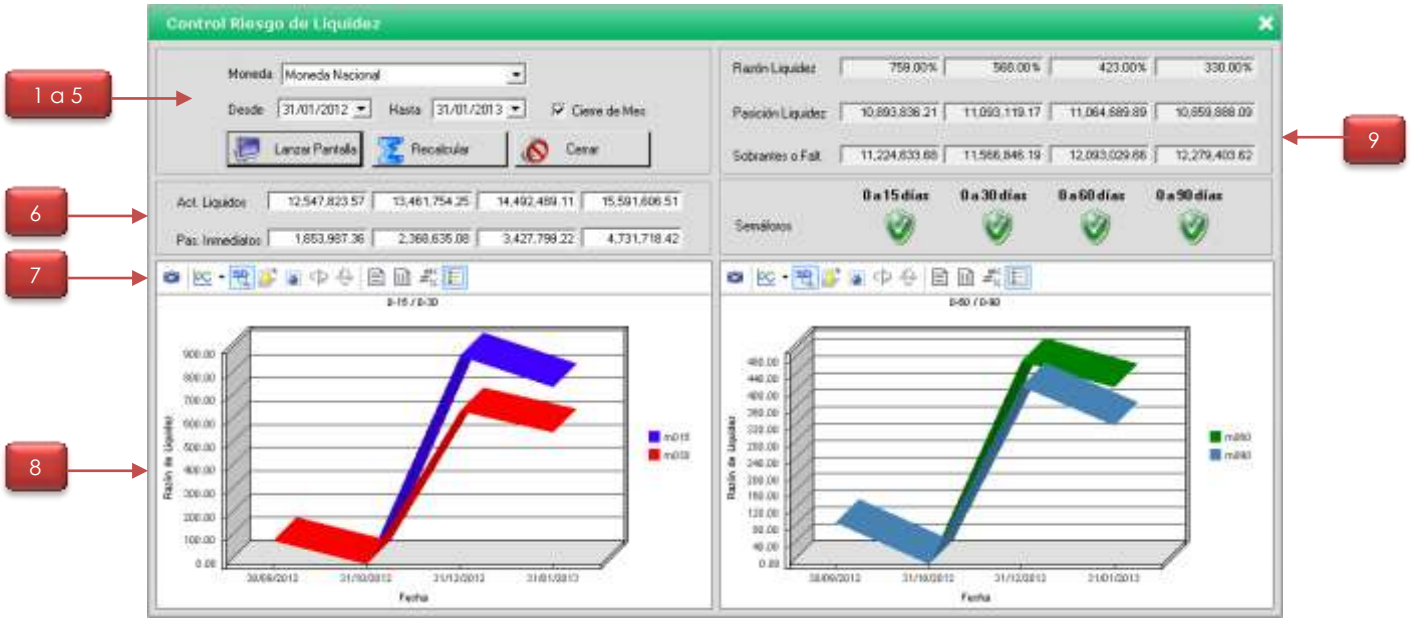
8. **Fechas y Cierre de Mes:** Permite seleccioanr el rango de tiempo en el que se desea visualizar el indicador. Es posible que el indicador se muestre solo para los cierres de mes, en tal caso se deberá seleccionar la opción Cierre de Mes.
9. **Cerrar:** Permite cerrar la pantalla.

Pasos para la utilización de la Pantalla:

1. Selecione la pantalla Control de Riesgo Tipo de Cambio incluida en el Menú Panel de Exposición.
2. Seleccione el rango de fechas que desea consultar.
3. Seleccione la Moneda.
4. Si lo desea puede seleccionar la opción Cierre de Mes, con lo que el indicador solo se mostrará para los cierres de mes dentro del periodo de tiempo seleccionado.
5. Haga clic en el botón Lanzar.
6. Si lo desea puede modidicar la información de los factores, lo que le permitirá recalcular el indicador.
7. Recuerde que la información del indicador que se muestra en la sección superior de la pantalla corresponde al valor a la Fecha de Hasta.
8. Al lado del indicador se mostrará un indicador sobre el nivel de exposición asumido. Si lo desea podrá modificar los límites del indidcador. (Consulte Sección 2.7 Configuración de Límites.)

8.5. Control Riesgo de Liquidez.

Esta pantalla permite visualizar el nivel de exposición a Riesgo de Liquidez medido por la Razón de Liquidez Ajustada.



Opciones de Pantalla:

1. **Moneda:** Permite seleccionar la moneda del indicador que se desea visualizar.
2. **Fechas y Cierre de Mes:** Permite seleccioanr el rango de tiempo en el que se desea visualizar el indicador. Es posible que el indicador se muestre solo para los cierres de mes, en tal caso se deberá seleccionar la opción Cierre de Mes.
3. **Lanzar a Pantalla:** Permite visualizar en pantalla el indicador deacuerdo con los parametros seleccionados.
4. **Recalcular:** Permite recalcular el indicador luego de realizar modificaciones en los factores que componen el indicador.
5. **Cerrar:** Permite cerrar la pantalla.
6. **Datos de composición del Indicador:** Muestra los principales factores que dan pie al cálculo del indicador.
7. **Barra de Graficación:** Esta barra permite seleccionar el tipo de gráfico, modificar la posición y otras opciones de personalización del gráfico.
8. **Gráfico:** Muestra el comportamiento del indicador para el periodo seleccionado.
9. **Valor del Indicador:** Muestra el valor del indicador para la Fecha Hasta seleccionada.

Pasos para la utilización de la Pantalla:

1. Selecione la pantalla Control Riesgo de Liquidez incluida en el Menú Panel de Exposición.
2. Seleccione el rango de fechas que desea consultar.
3. Seleccione la Moneda.
4. Si lo desea puede seleccionar la opción Cierre de Mes, con lo que el indicador solo se mostrará para los cierres de mes dentro del periodo de tiempo seleccionado.
5. Haga clic en el botón Lanzar.
6. Si lo desea puede modidicar la información de los factores, lo que le permitirá recalcular el indicador.
7. Recuerde que la información del indicador que se muestra en la sección superior de la pantalla corresponde al valor a la Fecha de Hasta.
8. Al lado del indicador se mostrará un indicador sobre el nivel de exposición asumido. Si lo desea podrá modificar los límites del indidcador. (Consulte Sección 2.7 Configuración de Límites.)

9. Menú: Ayuda

En el menú de ayuda podrá consultar el manual de usuario, solicitar acceso remoto, verificar la versión de la aplicación o consultar la información histórica cargada.

9.1. Acerca de

Esta pantalla permite verificar la versión del sistema que se está utilizando.

9.2. Manual de Usuario

Al seleccionar Manual de Usuario el sistema le mostrará la versión más reciente del manual de usuario del aplicativo. Requiere tener instalado Acrobat Reader. Podrá descargarlo del siguiente vínculo:

http://get.adobe.com/es/reader/?Language=Spanish

9.3. Solicitar Soporte Remoto.

Si el usuario experimenta problemas en el uso del aplicativo podrá solicitar soporte remoto, con esta opción, el personal de ASM podrá conectarse al computador del usuario para verificar de manera conjunta el origen del problema y las posibles soluciones.

Pasos para solicitar Soporte Remoto.

1. Abra la pantalla “Soporte Remoto” incluida en el menú “Ayuda”
2. La pantalla mostrará un ID y contraseña, tal y como se muestra a continuación
3. Los datos deberán ser proporcionados al personal de soporte de ASM, de esta manera se realizará la conexión al equipo del usuario.
4. En algunos casos el personal de seguridad podría restringir el acceso a esta herramienta, esto hará que no se muestre el ID y la contraseña; si esto sucede el botón inferior de la pantalla se mostrará en rojo. En tal caso solicite soporte al personal de tecnología o seguridad.
5. ASM solo podrá brindar soporte remoto si el ícono está marcado en verde y es proporcionado el usuario y la contraseña.

6. Si desea suspender la sesión de soporte remota, solo será necesario que cierre la pantalla.

9.4. Support Center.

En caso que presente dificultades en la utilización del aplicativo deberá acceder el Support Center y crear un Ticket, esto permitirá darle seguimiento al caso e igualmente llegar el control sobre el proceso de soporte.

9.5. Control de Versiones.

En caso que desee visualizar los cambios históricos sobre el aplicativo así como las mejoras incorporadas podrá consultar dentro del menú de ayuda la opción Control de Versiones.